

光大保德信量化核心证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	19
6.3 净资产（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注	22
7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60

8.2 盈利投资者数量占比	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	61
9 开放式基金份额变动.....	61
10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	62
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	63
10.9 其他重大事件	65
11 影响投资者决策的其他重要信息	66
12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信量化核心证券投资基金	
基金简称	光大保德信量化股票	
基金主代码	360001	
交易代码	360001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004 年 8 月 27 日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	980,027,111.47 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
下属分级基金的交易代码	360001	007479
报告期末下属分级基金的份额总额	932,714,317.95 份	47,312,793.52 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金借鉴了外方股东保德信投资的量化投资管理理念和长期经验，结合中国市场现行特点加以改进，形成光大保德信独特的量化投资策略；正常市场情况下不作主动资产配置，采用自下而上与自上而下相结合的方式选择股票；并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合，确保投资组合风险收益特征符合既定目标。 本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票及存托凭证资产的基准比例为基金资产净值的 90%，浮动范围为 85—95%；现金的基准比例为基金资产净值的 10%，浮动范围为 5—15%。 本基金建仓时间为 6 个月，基金在合同生效后 6 个月内达到上述比例限制。针对开放式基金申购/赎回的异常流动性需求，资产配置可不受上述比例限制，但基金管理人将在合理期限内调整投资组合，使基金资产配置比例恢复至正常市场情况下的水平，上述合理期限指 10 个交易日，法律法规另有规定时，从其规定。 本基金通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。该体系在构建投资组合时综合考量收益因素及风险因素，一方面通过光大保德信独特的多因素数量模型对所有股票的预期收益率进行估算，个股预期收益率的高低直接决定投资组合是否持有该股票；另一方面投资团队从风险控制的角度出发，重点关注数据以外的信息，通过行业分析和个股分析对多因素数量模型形成有效补充，由此形成的行业评级和个股评级将决定行业及个股权重相对业绩基准的偏离范围；然后由投资组合优化器通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，根据预先设定的风险目标构建投

投资组合，并对投资组合进行动态持续优化，使投资组合风险收益特征符合既定目标；最后由交易员根据具体投资方案进行交易。

1. 多因素数量模型的运用

本基金借鉴保德信投资的量化投资管理经验，根据中国市场运行特征从股票估值，成长趋势及数据质量三方面选取对 A 股股价波动具有较强解释度的共同指标作为多因素数量模型的参数，通过一定的量化技术估算出共同指标的收益贡献率，并按一定权重加总得出个股预期收益率，作为投资组合构建的重要依据。估值类指标主要判断股票价格是否正确反映了公司基本面状况；趋势类指标说明股票现有估值是否能够持续；质量类指标判断是否存在暗示现行基本面趋势可能逆转的警戒信号。同时数量小组还将根据市场变化趋势定期或不定期地对模型参数及相关系数进行复核，并做相应调整以确保参数的有效性。

2. 行业评级

行业评级首先根据行业特性的不同对行业进行划分，我们将行业划分为周期性行业，防御性行业及增长性行业，并根据行业动向和实际发展状况对行业划分进行动态调整；在此基础上通过行业景气定位图对行业的周期性变化特征进行分析，并判断每个行业目前所处的景气阶段；然后通过树状集群行业评价体系对行业进行系统性评价；最终确定行业评级及行业权重相对业绩基准的偏离范围，为投资组合优化提供行业层面的决策建议。

3. 个股评级

研究团队采用定量分析与定性分析相结合的股票评估模型对上市公司进行综合评级，为投资组合优化提供个股层面的决策建议。研究团队着重关注上市公司数据可靠性及消息面对股价的潜在影响，从财务评分模型及公司质量评分模型两方面着手对公司基本面进行全面系统的分析和判断，得出股票综合评级，并根据股票评级确定投资组合中单个股票相对业绩基准的偏离范围。

4. 投资组合优化器的运用

投资组合优化器以风险收益配比原则为核心，通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，对投资组合进行前瞻性的风险配置，根据预先设定的风险目标构建符合参数设置并处于有效边际曲线上的投资组合，即一定风险水平下收益最高的投资组合。投资组合优化器还通过量化模型预测投资组合整体风险程度，对投资组合进行动态持续优化。如果由于股价波动等因素造成事前跟踪误差超出我们预先设定的风险区域，投资团队将在优化器中根据风险归因分析对边际风险贡献率最大的股票进行调整，以降低事前跟踪误差，使投资组合所承担的风险程度符合既定目标，并使风险尽量集中分布在投资团队对该风险因素的把握具有高置信度的区域。

5. 权证的投资

(1) 权证的投资策略

在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，本公司对权证进行积极主动投资，获取较高的投资组合收益水平。权证投资策略主要包括以下几个方面：

A. 本公司主要采用 Black-Scholes 定价公式和二叉树模型对权证进行定价，并根据市场实际情况，调整权证定价模型及其参数，得到权证的理论价值，作为权证投资的价值基准。

	B. 权证价格的对于决定其风险因素的敏感度，本基金通过风险参数的形式进行衡量。 C. 本基金通过权证与证券的组合投资，进行基金财产的止损保护。 D. 本基金通过采取现金套利（Cash extraction）策略，兑现投资收益，保留未来获利空间。 E. 同时，本基金还将采用二叉树模型对美式权证以及各类复杂型权证进行理论定价。 F. 基金经理通过对理论价格和隐含波动率的合理性分析，基于对证券价格的未来表现和预期波动率变化的分析判断，主动投资于价值被市场低估的权证品种。 (2) 权证的投资决策流程 A. 权证的投资研究过程 研究人员对于基础股票进行深入的调研和分析，并将结果通过量化模型，对股票进行估值；数量分析小组负责构建和维护权证定价模型，在股票估值的基础上，对于权证的价值进行分析。投资组合委员会在研究分析的基础上，结合基金的实际执行情况确定投资策略。风险分析小组则通过独立的系统，对权证的风险进行测算，在各种可能的情景下，对权证进行估价，从而确定权证的投资风险，为投资组合委员会的投资策略确定提供参考。 B. 权证的投资决策过程 a. 权证投资方案的制定 投资组合委员会在研究人员和数量分析人员的工作基础上，结合基金的实际执行情况确定投资方案。 b. 权证投资的授权和审批 凡单个品种累计投资额度不超过基金资产净值的 5%（暂定）的权证投资，可由基金经理自主执行，并向投资总监备案。 凡单个品种累计投资额度超过基金资产净值的 5%（暂定）的权证投资，由投资组合委员会向公司投资决策委员会申请审批。投资方案得到批准后，由基金经理在授权的范围内实施。 c. 投资计划调整 投资组合委员会根据市场变化、投资计划的实施情况和执行效果、投资分析报告（包括投资表现评估报告、风险分析报告）等，进一步分析判断，并据此进行调整。如果遇有重大变化需要修改投资方案，须按相应程序批准后方可实施。
业绩比较基准	90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险限制范围内追求收益最大化。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		光大保德信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露	姓名	高顺平	王茵
	联系电话	(021) 80262888	010-63639180

负责人	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		4008-202-888	95595
传真		(021) 80262468	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢, 6层	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢(北区3号楼), 6-7层、10层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200010	100033
法定代表人		高瑞东	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.epf.com.cn
基金中期报告置备地点	光大保德信基金管理有限公司、中国光大银行股份有限公司的办公场所。

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢 (北区 3 号楼), 6-7 层、10 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)	
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
本期已实现收益	155,934,624.35	3,726,199.22
本期利润	113,146,294.66	-22,617.21
加权平均基金份额本期利润	0.1075	-0.0010
本期加权平均净值利润率	8.30%	-0.07%
本期基金份额净值增长率	9.06%	8.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
期末可供分配利润	732,334,925.86	8,421,763.28

期末可供分配基金份额利润	0.7852	0.1780
期末基金资产净值	1,225,320,815.52	63,322,566.71
期末基金份额净值	1.3137	1.3384
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
基金份额累计净值增长率	593.43%	41.03%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信量化股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.90%	1.24%	10.70%	1.13%	-3.80%	0.11%
过去六个月	9.06%	1.28%	6.86%	1.02%	2.20%	0.26%
过去一年	32.49%	1.04%	23.75%	0.92%	8.74%	0.12%
过去三年	35.35%	1.42%	26.92%	1.00%	8.43%	0.42%
过去五年	0.34%	1.29%	-3.40%	1.01%	3.74%	0.28%
过去七年	59.20%	1.28%	28.45%	1.05%	30.75%	0.23%
过去十年	44.55%	1.22%	53.79%	1.03%	-9.24%	0.19%
自基金合同生效起至今	593.43%	1.56%	293.83%	1.40%	299.60%	0.16%

光大保德信量化股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.78%	1.24%	10.70%	1.13%	-3.92%	0.11%
过去六个月	8.84%	1.28%	6.86%	1.02%	1.98%	0.26%
过去一年	32.44%	1.04%	23.75%	0.92%	8.69%	0.12%
过去三年	35.01%	1.42%	26.92%	1.00%	8.09%	0.42%
自基金合同生效起至今	41.03%	1.39%	21.55%	0.99%	19.48%	0.40%

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较

基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”。

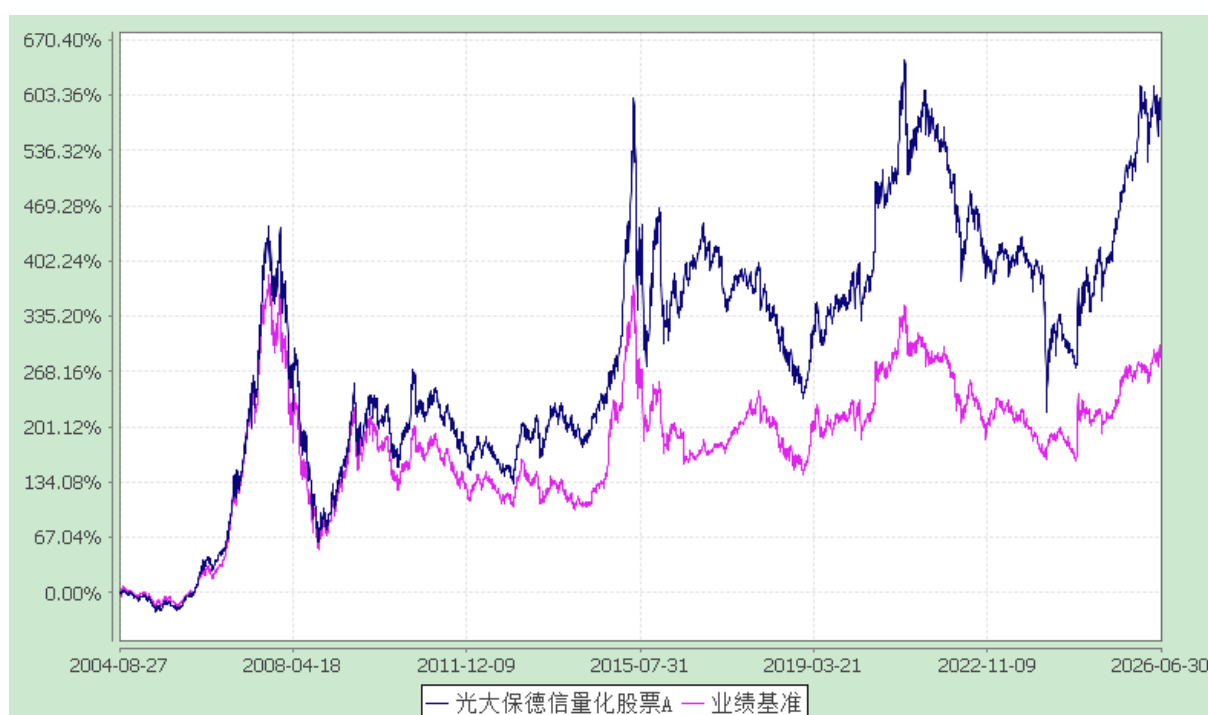
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

光大保德信量化核心证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004 年 8 月 27 日至 2026 年 6 月 30 日)

光大保德信量化股票 A



光大保德信量化股票 C



注：本基金 C 类份额设立于 2023 年 4 月 21 日。

为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55%和 45%的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2026 年 6 月 30 日，光大保德信旗下管理着 87 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金,光大保德信货币市场基金,光大保德信红利混合型证券投资基金,光大保德信新增长混合型证券投资基金,光大保德信优势配置混合型证券投资基金,光大保德信增利收益债券型证券投资基金,

光大保德信均衡精选混合型证券投资基金,光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信中小盘混合型证券投资基金,光大保德信信用添益债券型证券投资基金,光大保德信行业轮动混合型证券投资基金,光大保德信现金宝货币市场基金,光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金,光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金,光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金,光大保德信耀钱包货币市场基金,光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信风格轮动混合型证券投资基金,光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金,光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信安和债券型证券投资基金,光大保德信安祺债券型证券投资基金,光大保德信永利纯债债券型证券投资基金,光大保德信安诚债券型证券投资基金,光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金,光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金,光大保德信中高等级债券型证券投资基金,光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金,光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金,光大保德信超短债债券型证券投资基金,光大保德信晟利债券型证券投资基金,光大保德信安泽债券型证券投资基金,光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金,光大保德信景气先锋混合型证券投资基金,光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金,光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金,光大保德信研究精选混合型证券投资基金,光大保德信消费主题股票型证券投资基金,光大保德信瑞和混合型证券投资基金,光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金,光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金,光大保德信中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金,光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金,光大保德信智能汽车主题股票型证券投资基金,光大保德信锦弘混合型证券投资基金,光大保德信新机遇混合型证券投资基金,光大保德信安阳一年持有期混合型证券投资基金,光大保德信品质生活混合型证券投资基金,光大保德信健康优加混合型证券投资基金,光大保德信睿盈混合型证券投资基金,光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金,光大保德信创新生活混合型证券投资基金,光大保德信恒鑫混合型证券投资基金,光大保德信纯债债券型证券投资基金,光大保德信核心资产混合型证券投资基金,光大保德信尊利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金,光大保德信汇佳混合型证券投资基金,光大保德信尊颐纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金,光大保德信高端装备混合型证券投资基金,光大保德信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金,光大保德信荣利纯债债券型证券投资基金,光大保德信专精特新混合型证券投资基金,光大保德信睿阳纯债债券型证券投资基金,光大保德信数字经济主题混合型证券投资基金,光大保德信鼎利 90 天滚动持有债券型证券投资基金,光大保德信安选平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF),光大保德信红利量化选股混合型证券

投资基金,光大保德信沪深 300 指数增强型证券投资基金,光大保德信阳光三个月持有期混合型基金中基金 (FOF),光大保德信中证 A500 指数型证券投资基金,光大保德信添利 30 天滚动持有债券型证券投资基金,光大保德信国证通用航空产业指数型发起式证券投资基金,光大保德信国证机器人产业指数型发起式证券投资基金,光大保德信阳光香港精选混合型证券投资基金 (QDII),光大保德信阳光混合型证券投资基金,光大保德信阳光启明星创新驱动主题混合型证券投资基金,光大保德信阳光稳健增长混合型证券投资基金,光大保德信阳光价值 30 个月持有期混合型证券投资基金,光大保德信阳光优选一年持有期混合型证券投资基金,光大保德信阳光稳债中短债债券型证券投资基金,光大保德信阳光智造混合型证券投资基金,光大保德信阳光现金宝货币市场基金,光大保德信双鑫收益债券型证券投资基金,光大保德信北证 50 成份指数型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王卫林	基金经理	2023-08-22	-	10 年	王卫林先生,北京大学软件工程专业硕士。2016 年 7 月至 2018 年 1 月在南方基金管理有限公司任职量化研究员;2018 年 1 月至 2023 年 2 月在长城基金管理有限公司任职量化与指数投资部研究员、基金经理助理、基金经理;2023 年 2 月加入光大保德信基金管理有限公司,现任权益管理总部量化投资团队基金经理,2023 年 8 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金的基金经理,2025 年 7 月至今担任光大保德信中证 A500 指数型证券投资基金的基金经理,2025 年 8 月至今担任光大保德信国证通用航空产业指数型发起式证券投资基金的基金经理,2025 年 9 月至今担任光大保德信国证机器人产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。
朱剑涛	权益管理总部 量化投资团队	2024-05-06	-	18 年	朱剑涛先生,2008 年毕业于复旦大学,获得理学硕士。2008 年 7

	副团队长（主持工作）、基金经理				月至 2010 年 8 月在华宝信托有限责任公司任职量化研究助理；2010 年 9 月至 2015 年 3 月在海通证券股份有限公司任职金融工程高级分析师；2015 年 4 月至 2022 年 5 月在东方证券股份有限公司任职金融工程首席分析师；2022 年 6 月至 2023 年 8 月在海南进化论私募基金管理有限公司任职量化研究负责人；2023 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任权益管理总部量化投资团队副团队长（主持工作），2024 年 5 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金的基金经理，2024 年 5 月至 2026 年 4 月担任光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金的基金经理，2024 年 10 月至今担任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2024 年 10 月至 2026 年 4 月担任光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理，2025 年 3 月至今担任光大保德信红利量化选股混合型证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月至今担任光大保德信沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理，2026 年 1 月至今担任光大保德信双鑫收益债券型证券投资基金的基金经理，2026 年 4 月至今担任光大保德信健康优加混合型证券投资基金的基金经理，2026 年 7 月至今担任光大保德信中证科创创业人工智能指数型证券投资基金的基金经理。
--	-----------------	--	--	--	--

注：对基金的非首任基金经理，其任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为充分保护持有人利益，确保本基金管理人旗下各基金在获得投研团队、交易团队支持等各方面得到公平对待，本基金管理人从投研制度设计、组织结构设计、工作流程制定、技术系统建设和完善、公平交易执行效果评估等各方面出发，建设形成了有效的公平交易执行体系。本报告期，本基金管理人各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与公司旗下其他投资组合未发生交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金分别采用了机器学习和量化多因子模型。量化多因子模型基于资产定价理论，行为金融学理论和市场经验，总结出多个有效的选股指标，例如：估值、成长、反转因子等，根据市场环境给不同因子配比不同权重，对股票预期收益进行排序打分，控制风险暴露，定量构建组合。机器学习模型，除了会采用传统选股因子外，还会借助机器算力，让模型从不同类型输入数据中去学习挖掘低相关性的选股因子，根据市场风格变化自学习合适的因子配比权重。

2026 年上半年 A 股市场分化明显，科创 50 和创业板指领涨市场，半年度涨幅 64.3% 和 35.6%，对比之下，中证红利和万得小市值指数分别下跌 7.3% 和 8.7%。市场分化集中表现在二季度六月份，科技赛道持续领跑，传统行业面临转型压力；外需强于内需、新兴强于传统；市场成交极其活跃，数个交易日的全市场成交额突破 3.5 万亿。量化策略持仓比较分散，偏好低波和反转特征，在二季度的高波、高贝塔、高集中度、持续强动量的科技股行情中表现不佳。量化策略的修复需要等待市场热点集聚效应降低和整体波动率的均值回归。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内本基金 A 份额净值增长率为 9.06%，业绩比较基准收益率为 6.86%，C 份额净值增长率为 8.84%，业绩比较基准收益率为 6.86%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年下半年，国内经济估计将延续外需强于内需，生产强于需求，新动能强于传统动能的分化特征，AI 链条、高端制造、电子等行业受益，地产链、传统制造业和居民消费将承压，AI 算力产业链仍是共识度最高的主线。市场在经历了上半场的“拔估值”后，会逐步转向那些有成长空间和业绩支撑的公司，此外，市场风格或伴随着波动更趋于均衡；需把握攻守平衡，在风格轮动中捕捉结构性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管

机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，2026 年 2 月 3 日本基金 A 类基金份额每份派发红利 0.0278 元，C 类基金份额每份派发红利 0.0025 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在光大保德信量化核心证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	71,653,185.39	102,263,740.65
结算备付金		115,871.68	4,836,860.50
存出保证金		156,373.70	242,114.72
交易性金融资产	6.4.7.2	1,222,631,293.19	1,196,272,936.31
其中：股票投资		1,222,631,293.19	1,196,272,936.31
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		403,791.89	112,607.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,294,960,515.85	1,303,728,259.93
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		42,474.87	9,654,541.67
应付赎回款		3,803,732.18	3,473,908.31
应付管理人报酬		1,361,676.92	1,292,641.36
应付托管费		226,946.14	215,440.24
应付销售服务费		18,570.35	227.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	863,733.16	1,240,871.11
负债合计		6,317,133.62	15,877,630.05
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	388,621,305.45	383,300,966.57
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	900,022,076.78	904,549,663.31
净资产合计		1,288,643,382.23	1,287,850,629.88
负债和净资产总计		1,294,960,515.85	1,303,728,259.93

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3149 元，基金份额总额 980,027,111.47 份。

其中 A 类基金份额净值 1.3137 元，份额总额 932,714,317.95 份；C 类基金份额净值 1.3384 元，份额总额 47,312,793.52 份。

6.2 利润表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		122,955,838.54	132,079,764.55
1.利息收入		164,750.92	271,729.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	164,750.92	271,729.63
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		169,133,709.92	165,323,089.42
其中：股票投资收益	6.4.7.10	160,395,402.34	156,871,284.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	8,738,307.58	8,451,804.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-46,537,146.12	-33,600,485.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	194,523.82	85,431.45
减：二、营业总支出		9,832,161.09	7,344,391.01
1. 管理人报酬	6.4.10.2	8,282,215.70	6,201,293.74
2. 托管费	6.4.10.2	1,380,369.27	1,033,549.01
3. 销售服务费		60,331.62	172.09
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	109,244.50	109,376.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		113,123,677.45	124,735,373.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		113,123,677.45	124,735,373.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		113,123,677.45	124,735,373.54

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	383,300,966.57	-	904,549,663.31	1,287,850,629.88
二、本期期初净资产	383,300,966.57	-	904,549,663.31	1,287,850,629.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,320,338.88	-	-4,527,586.53	792,752.35
（一）、综合收益	-	-	113,123,677.45	113,123,677.4

总额				5
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	5,320,338.88	-	-88,668,326.04	-83,347,987.16
其中: 1.基金申购款	107,996,515.72	-	143,021,178.59	251,017,694.31
2.基金赎回款	-102,676,176.84	-	-231,689,504.63	-334,365,681.47
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-28,982,937.94	-28,982,937.94
四、本期期末净资产	388,621,305.45	-	900,022,076.78	1,288,643,382.23
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	403,559,683.19	-	587,143,407.34	990,703,090.53
二、本期期初净资产	403,559,683.19	-	587,143,407.34	990,703,090.53
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-8,521,084.41	-	111,375,708.74	102,854,624.33
(一)、综合收益总额	-	-	124,735,373.54	124,735,373.54
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-8,521,084.41	-	-13,359,664.80	-21,880,749.21
其中: 1.基金申购款	52,680,401.99	-	87,486,744.57	140,167,146.56
2.基金赎回款	-61,201,486.40	-	-100,846,409.37	-162,047,895.77
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-

四、本期期末净资产	395,038,598.78	-	698,519,116.08	1,093,557,714.86
-----------	----------------	---	----------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：高瑞东，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：李勇

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

光大保德信量化核心证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2004]85 号文《关于同意光大保德信量化核心证券投资基金设立的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2004 年 8 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 2,544,287,215.94 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。根据基金管理人光大保德信基金管理有限公司于 2023 年 4 月 20 日发布的《关于光大保德信量化核心证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2023 年 4 月 21 日起，本基金增设 C 类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括在国内依法公开发行上市的股票、存托凭证、法律法规及证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票投资对象重点为基本面良好且具有持续增长潜力，股价处于合理区间的优质股票。本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票及存托凭证资产的基准比例为基金资产净值的 90%，浮动范围为 85-95%；现金的基准比例为基金资产净值的 10%，浮动范围为 5-15%。

本基金的业绩比较基准为：90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率。2007 年 5 月 8 日，本基金管理人光大保德信基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面值为人民币 0.3618 元。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报

规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

6.4.6.2 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令

第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3% 的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	71,653,185.39
等于：本金	71,645,269.84
加：应计利息	7,915.55
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	71,653,185.39

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,199,707,778.52	-	1,222,631,293.19	22,923,514.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,199,707,778.52	-	1,222,631,293.19	22,923,514.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	8,207.67
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	626,429.55

其中：交易所市场	626,429.55
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	49,588.57
预提信息披露费	179,507.37
合计	863,733.16

6.4.7.7 实收基金

光大保德信量化股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	1,045,868,930.39	382,715,037.43
本期申购	131,462,566.37	48,105,975.92
本期赎回（以“-”号填列）	-244,617,178.81	-89,512,501.42
本期末	932,714,317.95	341,308,511.93

光大保德信量化股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	585,929.14	585,929.14
本期申购	59,890,539.80	59,890,539.80
本期赎回（以“-”号填列）	-13,163,675.42	-13,163,675.42
本期末	47,312,793.52	47,312,793.52

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

光大保德信量化股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	693,452,711.33	210,960,979.07	904,413,690.40
本期期初	693,452,711.33	210,960,979.07	904,413,690.40
本期利润	155,934,624.35	-42,788,329.69	113,146,294.66

本期基金份额交易产生的变动数	-88,099,354.10	-16,495,271.65	-104,594,625.75
其中：基金申购款	92,760,211.07	30,200,697.13	122,960,908.20
基金赎回款	-180,859,565.17	-46,695,968.78	-227,555,533.95
本期已分配利润	-28,953,055.72	-	-28,953,055.72
本期末	732,334,925.86	151,677,377.73	884,012,303.59

光大保德信量化股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,982.93	117,989.98	135,972.91
本期期初	17,982.93	117,989.98	135,972.91
本期利润	3,726,199.22	-3,748,816.43	-22,617.21
本期基金份额交易产生的变动数	4,707,463.35	11,218,836.36	15,926,299.71
其中：基金申购款	6,302,247.58	13,758,022.81	20,060,270.39
基金赎回款	-1,594,784.23	-2,539,186.45	-4,133,970.68
本期已分配利润	-29,882.22	-	-29,882.22
本期末	8,421,763.28	7,588,009.91	16,009,773.19

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	159,380.69
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,090.18
其他	1,280.05
合计	164,750.92

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,645,615,665.55
减：卖出股票成本总额	1,482,797,577.49
减：交易费用	2,422,685.72
买卖股票差价收入	160,395,402.34

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内未投资债券。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期末进行贵金属投资。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内未投资衍生工具。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,738,307.58
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,738,307.58

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-46,537,146.12
——股票投资	-46,537,146.12
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-46,537,146.12

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	194,523.82
合计	194,523.82

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	148.56
合计	109,244.50

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司（“光大保德信”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	171,961,040.40	5.37%	155,164,484.87	4.54%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	74,958.84	5.37%	74,958.84	11.97%
关联方名称	上年度可比期间			
	2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券	67,636.26	4.54%	65,728.74	7.37%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以未包含印花税、经手费、证管费和过户费等费用的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	8,282,215.70	6,201,293.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,267,311.30	2,627,383.66
应支付基金管理人的净管理费	5,014,904.40	3,573,910.08

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times\text{基金管理费率}/\text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,380,369.27	1,033,549.01

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H=E\times\text{基金托管费率}/\text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C	合计
光大证券	-	244.64	244.64
光大保德信	-	14,134.05	14,134.05
合计	-	14,378.69	14,378.69

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	光大保德信量化股票A	光大保德信量化股票C	合计
光大证券	-	30.08	30.08
光大保德信	-	21.15	21.15
合计	-	51.23	51.23

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.40%年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$H = E \times C$ 类基金销售服务费年费率/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2026年1月1日至2026年6月30日	2025年1月1日至2025年6月30日

	光大保德信量化股票A	光大保德信量化股票C	光大保德信量化股票A	光大保德信量化股票C
期初持有的基金份额	-	10,028.66	-	10,028.66
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	-	10,028.66	-	10,028.66
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.02%	-	10.39%

注：1.期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2.基金管理人投资本基金的费率标准与其他同条件的投资者适用的费率标准相一致。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

光大保德信量化股票 A

份额单位：份

关联方名称	光大保德信量化股票A本期末 2026年6月30日		光大保德信量化股票A上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
光大证券	4,633,553.64	0.50%	-	-

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

光大保德信量化股票 C

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金 C 类基金份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

光大银行	71,653,185.39	159,380.69	63,051,424.53	266,959.52
------	---------------	------------	---------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

光大保德信量化股票 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2026-02-03	-	2026-02-03	0.278	13,135,856.51	15,817,199.21	28,953,055.72	-
合计				0.278	13,135,856.51	15,817,199.21	28,953,055.72	-

光大保德信量化股票 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2026-02-03	-	2026-02-03	0.025	22,222.18	7,660.04	29,882.22	-

合计			0.025	22,222.18	7,660.04	29,882.22	-
----	--	--	-------	-----------	----------	-----------	---

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,117.00	41,662.56	299,534.33	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488.00	65,658.56	179,912.24	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717.00	16,259.99	120,430.38	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500.00	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116.00	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234.00	6,149.52	40,269.06	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743.00	13,630.26	36,149.82	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719.00	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834.00	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216.00	5,330.88	18,748.80	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通	7.08	28.40	546.00	3,865.68	15,506.40	-

				受限						
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195.00	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387.00	11,757.06	15,089.13	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775.00	8,664.50	13,632.25	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96.00	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177.00	9,903.15	10,106.70	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138.00	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104.00	1,639.04	4,857.84	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72.00	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134.00	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46.00	1,742.48	1,604.02	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603137	恒尚节能	2026-06-16	重大事项停牌	12.94	2026-07-01	14.23	41,700.00	526,227.85	539,598.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了内部管理制度和流程来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理工作委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均

以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2025 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的

可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为结算备付金、存出保证金及货币资金等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年6月30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	71,653,185.39	-	-	-	-	-	71,653,185.39
结算备付金	115,871.68	-	-	-	-	-	115,871.68
存出保证金	156,373.70	-	-	-	-	-	156,373.70
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,222,631,293.19	1,222,631,293.19
应收申购款	-	-	-	-	-	403,791.89	403,791.89
资产总计	71,925,430.77	-	-	-	-	1,223,035,085.08	1,294,960,515.85
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	42,474.87	42,474.87
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,803,732.18	3,803,732.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,361,676.92	1,361,676.92
应付托管费	-	-	-	-	-	226,946.14	226,946.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	18,570.35	18,570.35
其他负债	-	-	-	-	-	863,733.16	863,733.16
负债总计	-	-	-	-	-	6,317,133.62	6,317,133.62
利率敏感度缺口	71,925,430.77	-	-	-	-	1,216,717,951.46	1,288,643,382.23
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	102,263,74	-	-	-	-	-	102,263,74

	0.65						0.65
结算备付金	4,836,860.50	-	-	-	-	-	4,836,860.50
存出保证金	242,114.72	-	-	-	-	-	242,114.72
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,196,272,936.31	1,196,272,936.31
应收申购款	-	-	-	-	-	112,607.75	112,607.75
资产总计	107,342,715.87	-	-	-	-	1,196,385,544.06	1,303,728,259.93
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	9,654,541.67	9,654,541.67
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,473,908.31	3,473,908.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,292,641.36	1,292,641.36
应付托管费	-	-	-	-	-	215,440.24	215,440.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	227.36	227.36
其他负债	-	-	-	-	-	1,240,871.11	1,240,871.11
负债总计	-	-	-	-	-	15,877,630.05	15,877,630.05
利率敏感度缺口	107,342,715.87	-	-	-	-	1,180,507,914.01	1,287,850,629.88

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末持有的交易性固定收益类投资比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的基金管理人每日对投资组合的行业和个券的集中度进行监控，并定期分析其相对业绩比较基准的偏离度。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，通过压力测试来评估本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,222,631,29 3.19	94.88	1,196,272,936 .31	92.89
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,222,631,29 3.19	94.88	1,196,272,936 .31	92.89

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与其过去一年的整体水平保持一致。	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
业绩比较基准上升 1%	增加约 13,720,677.21	增加约 12,909,719.12
业绩比较基准下降 1%	减少约 13,720,677.21	减少约 12,909,719.12

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	1,221,147,031.53
第二层次	539,598.00
第三层次	944,663.66
合计	1,222,631,293.19

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,222,631,293.19	94.41
	其中：股票	1,222,631,293.19	94.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	71,769,057.07	5.54
8	其他各项资产	560,165.59	0.04
9	合计	1,294,960,515.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	874,230.00	0.07
B	采矿业	105,921,535.09	8.22
C	制造业	696,913,647.85	54.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	103,848,320.10	8.06
E	建筑业	5,707,832.35	0.44
F	批发和零售业	14,549,800.76	1.13

G	交通运输、仓储和邮政业	15,358,746.89	1.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	82,963,693.32	6.44
J	金融业	131,589,996.73	10.21
K	房地产业	11,004,546.64	0.85
L	租赁和商务服务业	9,412,493.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	27,965,136.35	2.17
N	水利、环境和公共设施管理业	14,054,652.80	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	992,592.00	0.08
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,474,069.31	0.11
S	综合	-	-
	合计	1,222,631,293.19	94.88

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	3,130,400	82,861,688.00	6.43
2	601398	工商银行	3,632,800	25,683,896.00	1.99
3	600547	山东黄金	1,075,500	24,833,295.00	1.93
4	601988	中国银行	3,800,900	21,741,148.00	1.69
5	600489	中金黄金	1,168,800	21,096,840.00	1.64
6	601288	农业银行	3,031,200	18,399,384.00	1.43
7	300136	信维通信	143,573	17,121,080.25	1.33
8	688498	源杰科技	8,800	16,596,800.00	1.29
9	688037	芯源微	35,363	15,526,125.15	1.20
10	000975	山金国际	733,100	12,462,700.00	0.97
11	600674	川投能源	853,100	12,088,427.00	0.94
12	688702	盛科通信	30,437	11,870,125.63	0.92
13	688002	睿创微纳	75,727	11,714,209.63	0.91
14	688220	翱捷科技	84,744	10,535,374.08	0.82
15	688432	有研硅	262,964	10,510,671.08	0.82

16	688266	泽璟制药	89,444	10,434,537.04	0.81
17	688052	纳芯微	33,596	9,686,062.76	0.75
18	002738	中矿资源	156,200	9,214,238.00	0.72
19	688469	芯联集成	859,000	9,113,990.00	0.71
20	301358	湖南裕能	118,800	9,013,356.00	0.70
21	688180	君实生物	263,825	8,922,561.50	0.69
22	688110	东芯股份	43,110	8,781,507.00	0.68
23	688728	格科微	416,800	8,769,472.00	0.68
24	601198	东兴证券	640,900	8,709,831.00	0.68
25	600176	中国巨石	119,000	8,672,720.00	0.67
26	688027	国盾量子	16,987	8,561,617.87	0.66
27	688018	乐鑫科技	65,130	8,331,429.60	0.65
28	688766	普冉股份	10,590	8,118,294.00	0.63
29	000783	长江证券	816,200	7,957,950.00	0.62
30	688768	容知日新	149,928	7,727,289.12	0.60
31	600352	浙江龙盛	636,700	7,710,437.00	0.60
32	688235	百济神州	30,253	7,702,716.33	0.60
33	688385	复旦微电	108,000	7,699,320.00	0.60
34	300073	当升科技	160,200	7,696,008.00	0.60
35	001359	平安电工	60,840	7,620,210.00	0.59
36	000415	渤海租赁	1,857,600	7,560,432.00	0.59
37	000987	越秀资本	944,711	7,387,640.02	0.57
38	600988	赤峰黄金	279,000	7,343,280.00	0.57
39	600601	方正科技	528,600	7,315,824.00	0.57
40	688981	中芯国际	45,779	7,270,620.78	0.56
41	002841	视源股份	210,500	7,268,565.00	0.56
42	688559	海目星	86,586	7,266,297.12	0.56
43	601658	邮储银行	1,416,900	6,985,317.00	0.54
44	301377	鼎泰高科	12,600	6,941,340.00	0.54
45	688378	奥来德	111,847	6,934,514.00	0.54
46	688709	成都华微	181,630	6,918,286.70	0.54
47	000967	盈峰环境	643,403	6,775,033.59	0.53
48	601328	交通银行	1,042,800	6,705,204.00	0.52
49	688290	景业智能	99,869	6,627,306.84	0.51
50	600685	中船防务	251,700	6,403,248.00	0.50
51	688041	海光信息	17,142	6,347,682.60	0.49
52	688428	诺诚健华	221,728	6,312,596.16	0.49
53	688281	华秦科技	125,252	6,291,407.96	0.49
54	300759	康龙化成	215,500	6,234,415.00	0.48
55	600801	华新建材	399,600	6,233,760.00	0.48
56	688059	华锐精密	31,031	6,197,201.01	0.48
57	300919	中伟新材	141,100	6,173,125.00	0.48
58	600183	生益科技	35,600	6,173,040.00	0.48
59	603379	三美股份	81,300	6,169,857.00	0.48

60	603009	北特科技	127,000	6,092,190.00	0.47
61	688531	日联科技	33,981	6,043,181.04	0.47
62	600808	马钢股份	2,416,400	6,041,000.00	0.47
63	301571	国科天成	92,600	6,035,668.00	0.47
64	688676	金盘科技	71,000	6,009,440.00	0.47
65	300308	中际旭创	4,700	5,969,000.00	0.46
66	605020	永和股份	145,900	5,941,048.00	0.46
67	688155	先惠技术	73,429	5,939,671.81	0.46
68	301305	朗坤科技	206,100	5,877,972.00	0.46
69	002683	广东宏大	200,200	5,863,858.00	0.46
70	300450	先导智能	142,800	5,814,816.00	0.45
71	601615	明阳智能	497,600	5,757,232.00	0.45
72	688484	南芯科技	99,960	5,646,740.40	0.44
73	000878	云南铜业	355,300	5,642,164.00	0.44
74	688182	灿勤科技	130,347	5,614,045.29	0.44
75	601156	东航物流	342,600	5,522,712.00	0.43
76	002602	世纪华通	387,900	5,469,390.00	0.42
77	002299	圣农发展	359,333	5,447,488.28	0.42
78	603259	药明康德	43,400	5,403,734.00	0.42
79	600188	兖矿能源	303,200	5,387,864.00	0.42
80	603606	东方电缆	129,580	5,378,865.80	0.42
81	001314	亿道信息	85,400	5,277,720.00	0.41
82	002517	恺英网络	324,300	5,269,875.00	0.41
83	603699	纽威股份	103,600	5,211,080.00	0.40
84	301316	慧博云通	131,400	5,174,532.00	0.40
85	688301	奕瑞科技	41,600	5,158,400.00	0.40
86	301257	普蕊斯	112,540	5,107,065.20	0.40
87	601088	中国神华	130,200	5,083,008.00	0.39
88	603569	长久物流	958,400	5,079,520.00	0.39
89	688103	国力电子	67,783	5,043,733.03	0.39
90	002923	润都股份	528,100	4,995,826.00	0.39
91	688390	固德威	45,872	4,977,570.72	0.39
92	688173	希荻微	259,391	4,964,743.74	0.39
93	301280	珠城科技	98,000	4,955,860.00	0.38
94	600372	中航机载	450,500	4,887,925.00	0.38
95	301487	盟固利	254,200	4,867,930.00	0.38
96	600639	浦东金桥	530,700	4,839,984.00	0.38
97	600114	东睦股份	127,600	4,818,176.00	0.37
98	002187	广百股份	1,023,600	4,790,448.00	0.37
99	000776	广发证券	204,700	4,789,980.00	0.37
100	000576	甘化科工	727,900	4,782,303.00	0.37
101	601939	建设银行	496,400	4,780,332.00	0.37
102	688562	航天软件	317,029	4,774,456.74	0.37
103	600226	亨通股份	492,100	4,719,239.00	0.37

104	601899	紫金矿业	186,000	4,676,040.00	0.36
105	688717	艾罗能源	56,400	4,656,948.00	0.36
106	688292	浩瀚深度	247,669	4,606,643.40	0.36
107	688008	澜起科技	14,652	4,540,654.80	0.35
108	600292	电投水电	369,000	4,442,760.00	0.34
109	600435	北方导航	390,000	4,368,000.00	0.34
110	002558	巨人网络	157,900	4,351,724.00	0.34
111	301219	腾远钴业	78,405	4,296,594.00	0.33
112	002161	远望谷	785,700	4,227,066.00	0.33
113	000923	河钢资源	340,500	4,225,605.00	0.33
114	600803	新奥股份	264,400	4,177,520.00	0.32
115	603045	福达合金	57,600	4,112,064.00	0.32
116	002948	青岛银行	803,700	4,082,796.00	0.32
117	688311	盟升电子	155,804	4,080,506.76	0.32
118	603218	日月股份	394,700	4,033,834.00	0.31
119	601688	华泰证券	194,400	4,008,528.00	0.31
120	605128	上海沿浦	165,229	4,005,150.96	0.31
121	688820	盛合晶微	21,170	3,988,385.66	0.31
122	001313	粤海饲料	562,500	3,988,125.00	0.31
123	300504	天邑股份	243,600	3,929,268.00	0.30
124	600583	海油工程	762,700	3,836,381.00	0.30
125	603077	和邦生物	1,635,134	3,793,510.88	0.29
126	601333	广深铁路	1,364,100	3,751,275.00	0.29
127	601225	陕西煤业	183,101	3,726,105.35	0.29
128	002396	星网锐捷	189,240	3,627,730.80	0.28
129	688321	微芯生物	136,898	3,604,524.34	0.28
130	688349	三一重能	234,818	3,564,537.24	0.28
131	688153	唯捷创芯	110,912	3,562,493.44	0.28
132	000603	盛达资源	153,900	3,555,090.00	0.28
133	000408	藏格矿业	51,200	3,549,184.00	0.28
134	600970	中材国际	494,800	3,527,924.00	0.27
135	688073	毕得医药	65,150	3,506,373.00	0.27
136	002244	滨江集团	460,800	3,502,080.00	0.27
137	002281	光迅科技	13,400	3,442,996.00	0.27
138	601689	拓普集团	60,900	3,435,978.00	0.27
139	300575	中旗股份	697,100	3,429,732.00	0.27
140	601336	新华保险	57,400	3,424,484.00	0.27
141	600933	爱柯迪	230,500	3,406,790.00	0.26
142	000034	神州数码	120,540	3,344,985.00	0.26
143	301116	益客食品	382,000	3,269,920.00	0.25
144	300604	长川科技	9,500	3,243,490.00	0.25
145	688280	精进电动	579,555	3,181,756.95	0.25
146	600388	紫金龙净	217,800	3,168,990.00	0.25
147	688347	华虹宏力	9,270	3,117,501.00	0.24

148	002074	国轩高科	113,000	3,108,630.00	0.24
149	688567	孚能科技	293,650	3,083,325.00	0.24
150	301283	聚胶股份	125,880	3,081,542.40	0.24
151	601601	中国太保	101,600	2,897,632.00	0.22
152	601666	平煤股份	405,000	2,895,750.00	0.22
153	600909	华安证券	257,200	2,857,492.00	0.22
154	688238	和元生物	508,586	2,756,536.12	0.21
155	001309	德明利	2,900	2,734,410.00	0.21
156	002625	光启技术	88,916	2,695,933.12	0.21
157	603311	金海高科	73,200	2,682,780.00	0.21
158	301115	联检科技	75,600	2,650,536.00	0.21
159	000555	神州信息	241,200	2,484,360.00	0.19
160	000807	云铝股份	112,000	2,479,680.00	0.19
161	688610	埃科光电	9,278	2,443,825.20	0.19
162	002043	兔宝宝	208,300	2,307,964.00	0.18
163	603305	旭升集团	186,600	2,261,592.00	0.18
164	688689	银河微电	31,647	2,048,193.84	0.16
165	300857	协创数据	5,892	2,002,690.80	0.16
166	301282	金禄电子	66,780	1,969,342.20	0.15
167	002606	大连电瓷	139,400	1,869,354.00	0.15
168	688061	灿瑞科技	36,848	1,830,240.16	0.14
169	605186	健麾信息	58,000	1,818,880.00	0.14
170	300409	道氏技术	90,800	1,809,644.00	0.14
171	301095	广立微	15,300	1,806,165.00	0.14
172	301418	协昌科技	32,200	1,799,336.00	0.14
173	688375	国博电子	16,688	1,740,558.40	0.14
174	603020	爱普股份	120,100	1,693,410.00	0.13
175	301222	浙江恒威	56,400	1,689,744.00	0.13
176	688809	强一股份	2,584	1,609,832.00	0.12
177	301203	国泰环保	37,100	1,567,475.00	0.12
178	600704	物产中大	318,800	1,504,736.00	0.12
179	688391	钜泉科技	41,552	1,490,470.24	0.12
180	603519	立霸股份	96,000	1,468,800.00	0.11
181	688571	杭华股份	164,799	1,441,991.25	0.11
182	301395	仁信新材	109,500	1,439,925.00	0.11
183	688045	必易微	17,341	1,400,805.98	0.11
184	001218	丽臣实业	63,188	1,393,927.28	0.11
185	603165	荣晟环保	104,000	1,355,120.00	0.11
186	688786	悦安新材	28,986	1,335,674.88	0.10
187	603527	众源新材	109,940	1,310,484.80	0.10
188	688355	明志科技	67,671	1,302,666.75	0.10
189	301107	瑜欣电子	60,220	1,282,686.00	0.10
190	688818	电科蓝天	17,168	1,266,122.03	0.10
191	688388	嘉元科技	27,600	1,214,400.00	0.09

192	688589	力合微	52,327	1,202,474.46	0.09
193	688409	富创精密	3,879	1,187,943.75	0.09
194	001230	劲旅环境	76,680	1,177,804.80	0.09
195	603201	常润股份	82,900	1,157,284.00	0.09
196	300864	南大环境	60,200	1,154,636.00	0.09
197	300105	龙源技术	162,500	1,148,875.00	0.09
198	688395	正弦电气	50,287	1,111,342.70	0.09
199	002763	汇洁股份	161,500	1,096,585.00	0.09
200	688329	艾隆科技	54,254	1,096,473.34	0.09
201	688576	西山科技	27,358	1,090,216.30	0.08
202	688113	联测科技	30,918	1,085,221.80	0.08
203	000779	甘咨询	138,600	1,079,694.00	0.08
204	002353	杰瑞股份	7,000	1,067,500.00	0.08
205	300923	研奥股份	47,200	1,051,616.00	0.08
206	301223	中荣股份	65,100	1,049,412.00	0.08
207	688080	映翰通	24,183	1,045,914.75	0.08
208	300982	苏文电能	69,100	1,044,101.00	0.08
209	600716	凤凰股份	309,400	1,039,584.00	0.08
210	603788	宁波高发	74,700	1,030,860.00	0.08
211	600883	博闻科技	145,700	1,019,900.00	0.08
212	300567	精测电子	3,200	1,016,320.00	0.08
213	002576	通达动力	71,400	1,010,310.00	0.08
214	601375	中原证券	252,800	1,008,672.00	0.08
215	002296	辉煌科技	113,300	1,006,104.00	0.08
216	301166	优宁维	39,000	1,005,810.00	0.08
217	002357	富临运业	112,800	1,003,920.00	0.08
218	600455	博通股份	45,200	992,592.00	0.08
219	603309	维力医疗	88,300	990,726.00	0.08
220	605259	绿田机械	54,860	984,188.40	0.08
221	301429	森泰股份	62,100	973,107.00	0.08
222	301065	本立科技	54,600	963,690.00	0.07
223	688162	巨一科技	40,622	960,304.08	0.07
224	300800	力合科技	102,700	949,975.00	0.07
225	603797	联泰环保	251,500	943,125.00	0.07
226	688120	华海清科	2,920	940,765.60	0.07
227	300787	海能实业	102,800	937,536.00	0.07
228	600854	春兰股份	228,800	931,216.00	0.07
229	600379	宝光股份	60,700	914,749.00	0.07
230	600287	苏豪时尚	206,900	912,429.00	0.07
231	603102	百合股份	28,900	912,373.00	0.07
232	603506	南都物业	97,400	909,716.00	0.07
233	603987	康德莱	130,300	899,070.00	0.07
234	601999	出版传媒	161,600	892,032.00	0.07
235	600584	长电科技	8,600	890,530.00	0.07

236	600731	湖南海利	173,300	887,296.00	0.07
237	301503	智迪科技	32,200	885,822.00	0.07
238	301318	维海德	43,100	879,240.00	0.07
239	001201	东瑞股份	80,500	874,230.00	0.07
240	605001	威奥股份	159,800	870,910.00	0.07
241	000419	通程控股	188,900	851,939.00	0.07
242	301258	富士莱	37,142	845,723.34	0.07
243	688132	邦彦技术	63,045	829,041.75	0.06
244	688232	新点软件	45,783	814,021.74	0.06
245	300515	三德科技	62,100	810,405.00	0.06
246	600386	北巴传媒	259,300	809,016.00	0.06
247	603586	金麒麟	65,200	807,828.00	0.06
248	603089	正裕工业	94,200	786,570.00	0.06
249	603896	寿仙谷	60,200	779,590.00	0.06
250	600879	航天电子	36,300	772,827.00	0.06
251	688695	中创股份	40,420	755,854.00	0.06
252	301290	东星医疗	26,530	722,942.50	0.06
253	603937	丽岛新材	49,800	698,196.00	0.05
254	603648	畅联股份	80,600	691,548.00	0.05
255	300475	香农芯创	2,300	690,000.00	0.05
256	301106	骏成科技	33,032	685,083.68	0.05
257	601138	工业富联	9,415	679,292.25	0.05
258	603182	嘉华股份	59,400	677,160.00	0.05
259	603599	广信股份	70,300	673,474.00	0.05
260	600638	新黄浦	149,000	651,130.00	0.05
261	688293	奥浦迈	15,617	651,072.73	0.05
262	601717	中创智领	46,800	650,988.00	0.05
263	300717	华信新材	30,256	644,452.80	0.05
264	688026	洁特生物	40,978	643,764.38	0.05
265	600768	富邦新材	42,500	636,650.00	0.05
266	301586	佳力奇	18,700	629,442.00	0.05
267	603558	健盛集团	55,400	614,386.00	0.05
268	603041	美思德	58,100	602,497.00	0.05
269	002830	名雕股份	34,260	592,355.40	0.05
270	603096	新经典	43,500	582,030.00	0.05
271	601918	新集能源	66,500	571,235.00	0.04
272	300826	测绘股份	40,800	571,200.00	0.04
273	688616	西力科技	55,574	561,297.40	0.04
274	300636	同和药业	87,900	559,923.00	0.04
275	688785	恒运昌	1,155	556,632.57	0.04
276	600282	南钢股份	120,800	554,472.00	0.04
277	001399	惠科股份	16,218	551,403.64	0.04
278	688536	思瑞浦	1,500	546,135.00	0.04
279	603137	恒尚节能	41,700	539,598.00	0.04

280	300373	扬杰科技	3,400	534,582.00	0.04
281	600051	宁波联合	94,600	532,598.00	0.04
282	002436	兴森科技	10,200	519,690.00	0.04
283	688813	泰金新能	2,337	481,899.06	0.04
284	300771	智莱科技	46,350	478,332.00	0.04
285	002295	精艺股份	54,300	460,464.00	0.04
286	002817	黄山胶囊	78,516	460,103.76	0.04
287	301526	国际复材	9,200	429,364.00	0.03
288	301359	东南电子	26,660	423,360.80	0.03
289	688577	浙海德曼	9,068	415,586.44	0.03
290	002195	岩山科技	63,400	414,636.00	0.03
291	000969	安泰科技	14,963	367,192.02	0.03
292	301419	阿莱德	6,525	336,624.75	0.03
293	601121	宝地矿业	57,900	326,556.00	0.03
294	603926	铁流股份	17,729	313,626.01	0.02
295	002381	双箭股份	48,830	252,939.40	0.02
296	688811	有研复材	8,337	252,717.42	0.02
297	301006	迈拓股份	19,800	248,490.00	0.02
298	688433	华曙高科	2,886	247,041.60	0.02
299	301669	高特电子	5,455	217,413.57	0.02
300	688233	神工股份	905	194,050.10	0.02
301	688712	北芯生命	4,998	184,285.44	0.01
302	600596	新安股份	8,920	142,363.20	0.01
303	688143	长盈通	775	136,307.00	0.01
304	688028	沃尔德	773	120,487.51	0.01
305	301026	浩通科技	5,860	118,489.20	0.01
306	603214	爱婴室	8,600	104,146.00	0.01
307	688816	易思维	1,766	103,714.69	0.01
308	001365	天海电子	2,394	88,339.39	0.01
309	300661	圣邦股份	590	84,653.20	0.01
310	688012	中微公司	149	69,806.50	0.01
311	603435	嘉德利	1,031	68,134.86	0.01
312	301319	唯特偶	396	66,262.68	0.01
313	603385	惠达卫浴	13,000	63,440.00	0.00
314	001393	维通利	1,287	63,383.13	0.00
315	000965	天保基建	21,100	61,612.00	0.00
316	688181	八亿时空	919	57,529.40	0.00
317	603136	天目湖	5,400	45,252.00	0.00
318	001257	盛龙股份	1,807	37,927.74	0.00
319	688226	威腾电气	773	33,107.59	0.00
320	001227	兰州银行	15,700	31,400.00	0.00
321	300710	万隆光电	900	31,050.00	0.00
322	300224	正海磁材	1,900	25,327.00	0.00
323	688557	兰剑智能	774	24,017.22	0.00

324	300987	川网传媒	1,930	23,739.00	0.00
325	301696	三瑞智能	257	23,593.77	0.00
326	301093	华兰股份	160	21,700.80	0.00
327	688111	金山办公	100	21,305.00	0.00
328	688077	大地熊	774	20,503.26	0.00
329	301683	慧谷新材	152	19,520.40	0.00
330	601187	厦门银行	2,800	19,124.00	0.00
331	301687	新广益	242	18,822.76	0.00
332	002936	郑州银行	11,000	18,150.00	0.00
333	601963	重庆银行	1,800	18,144.00	0.00
334	600513	联环药业	1,200	17,448.00	0.00
335	600908	无锡银行	3,400	17,272.00	0.00
336	601860	紫金银行	7,000	16,940.00	0.00
337	002807	江阴银行	4,480	16,620.80	0.00
338	603323	苏农银行	4,118	15,936.66	0.00
339	688118	普元信息	774	15,572.88	0.00
340	601528	瑞丰银行	3,500	15,470.00	0.00
341	688737	中自科技	789	15,101.46	0.00
342	601112	振石股份	841	14,835.43	0.00
343	688360	德马科技	821	14,695.90	0.00
344	688722	同益中	851	12,909.67	0.00
345	600809	山西汾酒	100	10,937.00	0.00
346	688613	奥精医疗	774	10,921.14	0.00
347	301373	凌玮科技	66	10,263.00	0.00
348	301513	尚水智能	179	9,880.75	0.00
349	301042	安联锐视	106	7,070.20	0.00
350	002769	普路通	900	5,877.00	0.00
351	002718	友邦吊顶	50	5,512.50	0.00
352	600671	天目药业	300	5,064.00	0.00
353	002660	茂硕电源	700	4,550.00	0.00
354	300153	科泰电源	200	4,524.00	0.00
355	301275	汉朔科技	97	4,355.30	0.00
356	603293	埃泰克	116	4,252.24	0.00
357	001312	福恩股份	233	4,144.37	0.00
358	001316	润贝航科	112	3,693.76	0.00
359	301178	天亿马	70	3,482.50	0.00
360	688509	正元地信	773	3,308.44	0.00
361	600276	恒瑞医药	60	3,122.40	0.00
362	002365	永安药业	300	3,036.00	0.00
363	603881	数据港	113	2,825.00	0.00
364	003041	真爱美家	60	2,619.00	0.00
365	300810	中科海讯	99	2,512.62	0.00
366	001285	瑞立科密	61	2,508.93	0.00
367	300980	祥源新材	82	2,411.62	0.00

368	603228	景旺电子	33	2,389.53	0.00
369	605287	德才股份	50	2,074.50	0.00
370	603284	林平发展	56	1,959.82	0.00
371	300357	我武生物	84	1,958.88	0.00
372	301575	艾芬达	73	1,957.13	0.00
373	301276	嘉曼服饰	90	1,918.80	0.00
374	300623	捷捷微电	41	1,844.59	0.00
375	603928	兴业股份	122	1,805.60	0.00
376	301181	标榜股份	78	1,804.92	0.00
377	605288	凯迪股份	21	1,781.85	0.00
378	002956	西麦食品	84	1,743.84	0.00
379	301491	汉桑科技	43	1,688.61	0.00
380	301379	天山电子	56	1,592.64	0.00
381	301160	翔楼新材	32	1,492.80	0.00
382	301668	昊创瑞通	45	1,480.50	0.00
383	300789	唐源电气	79	1,403.83	0.00
384	300652	雷迪克	39	1,306.89	0.00
385	603288	海天味业	39	1,293.24	0.00
386	603579	荣泰健康	70	1,187.90	0.00
387	002293	罗莱生活	116	1,147.24	0.00
388	603331	百达精工	100	1,066.00	0.00
389	603262	技源集团	43	1,058.66	0.00
390	300407	凯发电气	95	1,026.00	0.00
391	002051	中工国际	89	1,007.48	0.00
392	603725	天安新材	80	904.00	0.00
393	301632	广东建科	57	882.36	0.00
394	605208	永茂泰	55	877.25	0.00
395	301539	宏鑫科技	61	799.10	0.00
396	300701	森霸传感	75	717.75	0.00
397	300590	移为通信	50	717.50	0.00
398	300246	宝莱特	50	703.50	0.00
399	301380	挖金客	25	689.75	0.00
400	300932	三友联众	64	678.40	0.00
401	601577	长沙银行	75	653.25	0.00
402	605339	南侨食品	54	644.76	0.00
403	301220	亚香股份	20	644.40	0.00
404	300628	亿联网络	19	642.58	0.00
405	002014	永新股份	60	633.60	0.00
406	002578	闽发铝业	200	630.00	0.00
407	603967	中创物流	60	621.00	0.00
408	300845	捷安高科	46	610.88	0.00
409	600969	郴电国际	80	610.40	0.00
410	601952	苏垦农发	80	599.20	0.00
411	603909	建发合诚	69	588.57	0.00

412	300741	华宝股份	45	563.40	0.00
413	003017	大洋生物	24	552.00	0.00
414	603238	诺邦股份	50	550.00	0.00
415	601139	深圳燃气	95	537.70	0.00
416	300897	山科智能	38	529.34	0.00
417	603317	天味食品	40	520.40	0.00
418	002442	龙星科技	100	493.00	0.00
419	002873	新天药业	66	483.12	0.00
420	603269	海鸥股份	27	444.69	0.00
421	001914	招商积余	54	440.64	0.00
422	000541	佛山照明	80	436.80	0.00
423	002507	涪陵榨菜	40	432.00	0.00
424	600295	鄂尔多斯	40	428.80	0.00
425	000153	丰原药业	80	405.60	0.00
426	603370	华新精科	11	395.78	0.00
427	603535	嘉诚国际	65	389.35	0.00
428	301237	和顺科技	5	370.40	0.00
429	002981	朝阳科技	20	368.80	0.00
430	003011	海象新材	20	363.40	0.00
431	300824	北鼎股份	50	359.00	0.00
432	603602	纵横通信	30	330.60	0.00
433	603183	建研院	90	319.50	0.00
434	603866	桃李面包	80	294.40	0.00
435	603025	大豪科技	20	272.80	0.00
436	300963	中洲特材	20	268.60	0.00
437	601200	上海环境	40	264.00	0.00
438	002890	弘宇股份	18	257.22	0.00
439	002696	百洋股份	50	248.50	0.00
440	603601	再升科技	20	245.60	0.00
441	301082	久盛电气	27	241.92	0.00
442	605189	富春染织	20	241.00	0.00
443	603966	法兰泰克	26	211.90	0.00
444	600548	深高速	26	211.38	0.00
445	300277	汽轮科技	14	210.56	0.00
446	000513	丽珠集团	7	202.23	0.00
447	300371	汇中股份	20	195.60	0.00
448	605169	洪通燃气	22	195.58	0.00
449	605158	华达新材	30	192.00	0.00
450	603697	有友食品	20	191.80	0.00
451	600615	鑫源智造	20	184.80	0.00
452	002140	东华科技	20	183.40	0.00
453	603308	应流股份	3	181.20	0.00
454	002732	燕塘乳业	14	173.60	0.00
455	605066	天正电气	25	169.75	0.00

456	003019	宸展光电	5	162.75	0.00
457	301057	汇隆新材	7	161.00	0.00
458	603161	科华控股	12	159.24	0.00
459	002687	乔治白	27	141.48	0.00
460	300413	芒果超媒	8	117.04	0.00
461	300040	九洲集团	18	102.42	0.00
462	000088	盐田港	24	98.16	0.00
463	001356	富岭股份	9	74.34	0.00
464	603180	金牌家居	3	41.16	0.00
465	300535	达威股份	3	40.89	0.00
466	002820	桂发祥	2	16.80	0.00
467	300183	东软载波	1	10.45	0.00
468	300002	神州泰岳	1	7.81	0.00
469	600757	长江传媒	1	7.31	0.00
470	603567	珍宝岛	1	4.38	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300136	信维通信	24,960,803.65	1.94
2	688498	源杰科技	16,212,111.19	1.26
3	688525	佰维存储	14,828,115.08	1.15
4	688235	百济神州	12,639,585.37	0.98
5	301308	江波龙	12,606,522.00	0.98
6	002738	中矿资源	12,164,884.04	0.94
7	300450	先导智能	11,485,699.00	0.89
8	000426	兴业银锡	10,672,607.00	0.83
9	300857	协创数据	10,657,063.60	0.83
10	600685	中船防务	10,259,680.00	0.80
11	688037	芯源微	10,020,175.85	0.78
12	301358	湖南裕能	9,979,601.00	0.77
13	300058	蓝色光标	9,971,547.00	0.77
14	688027	国盾量子	9,666,827.78	0.75
15	688347	华虹宏力	9,443,779.86	0.73
16	601615	明阳智能	9,435,041.00	0.73
17	603228	景旺电子	9,336,799.00	0.72
18	688280	精进电动	9,191,799.75	0.71
19	688702	盛科通信	9,126,457.82	0.71
20	300308	中际旭创	9,021,503.00	0.70

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688419	耐科装备	23,433,044.86	1.82
2	688525	佰维存储	18,699,116.17	1.45
3	601398	工商银行	17,593,883.00	1.37
4	000933	神火股份	17,129,288.92	1.33
5	601168	西部矿业	16,858,036.00	1.31
6	688347	华虹宏力	15,932,883.35	1.24
7	688549	中巨芯	15,829,343.48	1.23
8	300857	协创数据	15,475,337.20	1.20
9	603061	金海通	15,322,036.00	1.19
10	301308	江波龙	15,297,899.00	1.19
11	688248	南网科技	15,246,720.78	1.18
12	688610	埃科光电	15,024,049.33	1.17
13	300136	信维通信	14,416,566.62	1.12
14	001389	广合科技	13,498,695.60	1.05
15	002897	意华股份	12,554,150.00	0.97
16	688377	迪威尔	12,462,490.97	0.97
17	000975	山金国际	12,211,030.00	0.95
18	300058	蓝色光标	12,159,807.00	0.94
19	002049	紫光国微	11,880,210.00	0.92
20	300373	扬杰科技	11,856,422.00	0.92

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,555,693,080.49
卖出股票的收入（成交）总额	1,645,615,665.55

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券中，工商银行(601398 SH)的发行主体中国工商银行股份有限公司于 2025 年 12 月 18 日收到国家外汇管理局北京市分局的公开处罚（京汇罚[2025]49 号）、于 2025 年 12 月 19 日收到中国人民银行的行政处罚（银罚决字(2025)110 号）、于 2026 年 6 月 5 日收到国家金融监督管理总局的行政处罚。

中国银行(601988 SH)的发行主体中国银行股份有限公司于 2025 年 10 月 31 日收到金融监管总局的行政处罚。

农业银行(601288 SH)的发行主体中国农业银行股份有限公司于 2025 年 10 月 31 日收到金融监管总局的公开处罚。

基金管理人按照内部研究工作规范对以上证券进行分析后将其列入基金投资对象备选库并跟踪研究。

以上处罚事件发生后，基金管理人密切跟踪相关进展，遵循价值投资的理念进行投资决策。

除上述证券发行主体外，本基金本报告期末投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查

或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	156,373.70
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	403,791.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	560,165.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
光大保德信量化 股票 A	61,871	15,075.15	69,914,340.55	7.50%	862,799,977.40	92.50%
光大保德信量化 股票 C	92	514,269.49	47,088,875.21	99.53%	223,918.31	0.47%
合计	61,963	15,816.33	117,003,215.76	11.94%	863,023,895.71	88.06%

注：1、机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	98.38%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人 员持有本基金	光大保德信量化股票 A	347,950.02	0.04%
	光大保德信量化股票 C	4,200.47	0.01%
	合计	352,150.49	0.04%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人 持有本开放式基金	光大保德信量化股票 A	10~50
	光大保德信量化股票 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开 放式基金	光大保德信量化股票 A	0~10
	光大保德信量化股票 C	-
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
基金合同生效日（2004 年 8 月 27 日）基金份额总额	2,544,287,215.94	-

本报告期期初基金份额总额	1,045,868,930.39	585,929.14
本报告期基金总申购份额	131,462,566.37	59,890,539.80
减：本报告期基金总赎回份额	244,617,178.81	13,163,675.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	932,714,317.95	47,312,793.52

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，经光大保德信基金管理有限公司董事会会议审议通过，自 2026 年 3 月 26 日起，汪沛先生任董事长，王翠婷女士不再担任董事长。

2、本报告期内，经光大保德信基金管理有限公司董事会会议审议通过，自 2026 年 3 月 26 日起，黄波先生任副总经理兼首席投资总监，董文卓先生不再担任副总经理兼首席投资总监。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内管理人及其相关高级管理人员未受到任何调查或处罚。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受到任何调查或处罚。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	佣金	占当期佣 金总量的 比例	
国海证券股份 有限公司	2	1,218,213,142.26	38.07%	531,021.94	38.07%	-
长江证券股份 有限公司	1	922,381,684.03	28.83%	402,048.51	28.83%	-
中泰证券股份 有限公司	1	385,134,399.91	12.04%	167,880.03	12.04%	-
兴业证券股份 有限公司	1	252,366,079.05	7.89%	110,004.00	7.89%	-
申万宏源证券 有限公司	2	223,798,706.62	6.99%	97,553.58	6.99%	-
光大证券股份 有限公司	3	171,961,040.40	5.37%	74,958.84	5.37%	-
国金证券股份 有限公司	1	25,781,277.64	0.81%	11,237.61	0.81%	-
国泰海通证券 股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
金融街证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）本报告期内本基金租用证券公司交易单元情况无变更。

（2）基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

近两年未发生就交易席位方面的违约、侵权等各种纠纷或出现重大舆情事件；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；

（3）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报公司管理层（销售分管领导除外）批准。

经公司管理层（销售分管领导除外）批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事宜。

10.8.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
中泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
金融街证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2025 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2026-01-01
2	光大保德信量化核心证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	同上	2026-01-22

3	光大保德信量化核心证券投资基金暂停机构投资者大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2026-01-28
4	光大保德信量化核心证券投资基金分红公告	同上	2026-01-30
5	光大保德信量化核心证券投资基金恢复机构投资者大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2026-02-02
6	光大保德信量化核心证券投资基金(光大保德信量化股票 A)基金产品资料概要更新	同上	2026-03-27
7	光大保德信量化核心证券投资基金(光大保德信量化股票 C)基金产品资料概要更新	同上	2026-03-27
8	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2026-03-27
9	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2026-03-28
10	光大保德信量化核心证券投资基金 2025 年年度报告	同上	2026-03-31
11	关于网站、微信服务号在线客服暂停使用的公告	同上	2026-04-03
12	光大保德信基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	同上	2026-04-14
13	光大保德信量化核心证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	同上	2026-04-22
14	光大保德信基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	同上	2026-06-06
15	关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的通知	同上	2026-06-19

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期不存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信量化核心证券投资基金设立的文件

- 2、 光大保德信量化核心证券投资基金基金合同
- 3、 光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书
- 4、 光大保德信量化核心证券投资基金托管协议
- 5、 光大保德信量化核心证券投资基金法律意见书
- 6、 报告期内光大保德信量化核心证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 7、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 8、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9、 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层本基金管理人办公地址。

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。 客户服务中心电话：4008-202-888。 公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日